

# 平安量化先锋混合型发起式证券投资基金（C类份额）

## 基金产品资料概要（更新）

编制日期：2020年8月26日

送出日期：2020年8月27日

本概要提供本基金的重要信息，是招募说明书的一部分。

作出投资决定前，请阅读完整的招募说明书等销售文件。

### 一、产品概况

基金简称	平安量化先锋混合	基金主代码	005084
下属基金份额类别	平安量化先锋混合C	下属基金份额类别代码	005085
基金管理人	平安基金管理有限公司	基金托管人	平安银行股份有限公司
基金合同生效日	2017年11月1日		
基金类型	混合型	交易币种	人民币
运作方式	普通开放式	开放频率	每个开放日
基金经理	毛时超	开始担任本基金基金经理的日期	2020年6月1日
		证券从业日期	2016年7月5日
其他	基金合同生效三年后的对日，若基金资产规模低于两亿元，基金合同自动终止，且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续基金合同期限		

### 二、基金投资与净值表现

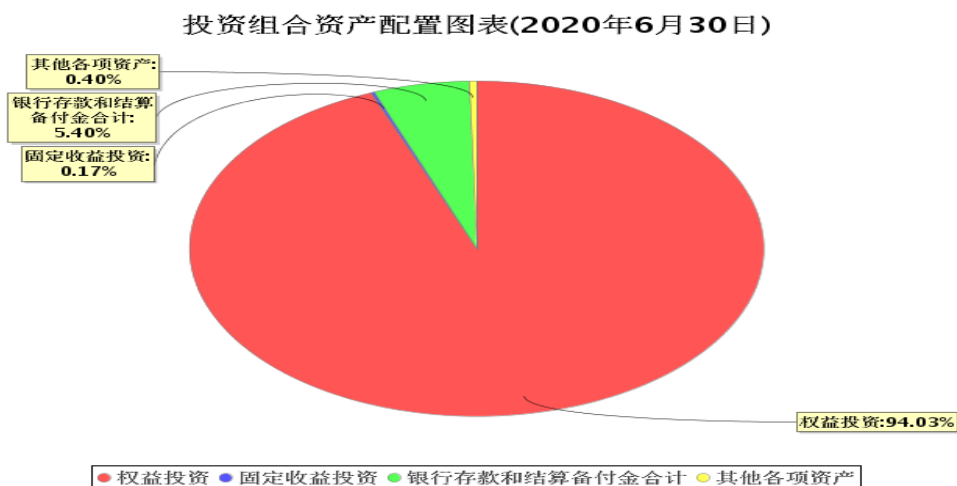
#### （一）投资目标与投资策略

投资目标	本基金利用数量化投资模型指导投资组合的构建，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资范围	<p>本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票），债券（包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、可转换公司债券（含可分离交易可转债）、可交换债券、中小企业私募债券、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、次级债），资产支持证券，债券回购、银行存款（协议存款、通知存款以及定期存款等其它银行存款）、同业存单、货币市场工具，权证、股指期货、国债期货，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。</p> <p>本基金股票投资占基金资产的比例范围为60%-95%。本基金每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</p>

	如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。
<b>主要投资策略</b>	本基金采用数量化投资策略建立投资模型，采用自上而下的资产配置和自下而上的个股选择相结合的方式，切实贯彻数量化的投资策略，以保证在控制风险的前提下实现收益最大化。
<b>业绩比较基准</b>	中证 500 指数收益率×95%+商业银行活期存款利率(税后)×5%
<b>风险收益特征</b>	本基金为混合型基金，其长期平均风险和预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。

注：详见本基金招募说明书第九部分“基金的投资”。

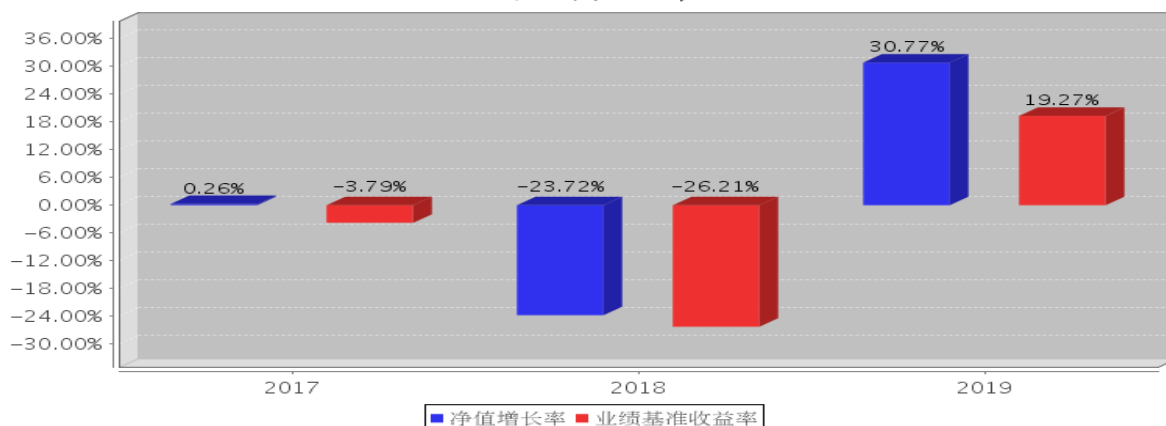
**(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表**



注：由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

**(三) 自基金合同生效以来/最近十年（孰短）基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的对比图**

**平安量化先锋混合C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图(2019年12月31日)**



注：1、数据截止日期为2019年12月31日。

2、本基金基金合同于 2017 年 11 月 01 日正式生效；自 2019 年 4 月 9 月起，业绩比较基准由中证 500 指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20%修改为中证 500 指数收益率×95%+商业银行活期存款利率(税后)×5%。

3、基金的过往业绩不代表未来表现。

### 三、投资本基金涉及的费用

#### (一) 基金销售相关费用

以下费用在赎回基金过程中收取：

费用类型	金额 (M) / 持有期限 (N)	收费方式 / 费率
赎回费	N<7 日	1.50%
	7 日≤N<30 日	0.50%
	30 日≤N	0.00%

注：本基金 C 类份额不收取申购费

#### (二) 基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除：

费用类别	收费方式/年费率
管理费	1.50%
托管费	0.25%
销售服务费	0.80%
其他费用	会计师费、律师费、审计费等

注：

- 1、本基金交易证券、基金等产生的费用和税负，按实际发生额从基金资产扣除。
- 2、本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务。

### 四、风险揭示与重要提示

#### (一) 风险揭示

本基金不提供任何保证。投资者可能损失本金。

投资有风险，投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。

投资于本基金的主要风险包括：市场风险、管理风险、流动性风险、操作和技术风险及合规性风险。

本基金特有风险包括：投资中小企业私募债券的特定风险、投资股指期货的特定风险、投资国债期货的风险、投资资产支持证券的风险、投资科创板的风险。

另外、本《基金合同》生效后三年基金无法继续存续的风险和量化模型存在的风险。本基金的《基金合同》生效之日起三年后的对应日，若基金资产规模低于 2 亿元，基金合同自动终止，且不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限，存在着基金无法继续存续的风险。

本基金采用量化模型构建投资组合，其主要工作流程包括采集数据、调用模型分析数据、计算目标持仓等几个部分，蕴含了数据风险和模型风险。

本基金建立量化模型的数据来源包括宏观数据、行业信息、上市公司基本财务数据、证券及期货市场交易行情数据、卖方分析师预期及评级数据等多种数据，广泛涵盖各类信息源，相关数据来源于不同数据提供商，且按不同的需求和规范进行预处理。在数据采集、预处理等过程

中可能发生数据错误风险，从而对量化模型输出结果造成影响。

本基金基于量化模型进行投资决策，量化投资方法的缺陷在一定程度上会影响本基金的表现。一方面，面对不断变换的市场环境，量化投资策略所遵循的模型理论均处于不断发展和完善的过程中；另一方面，在量化模型的实际运用中，核心参数假定的变动均可能影响整体效果的稳定性；最后，定量模型存在对历史数据的依赖。因此，在实际运用过程中，市场环境的变化可能导致遵循量化模型构建的投资组合在一定程度上无法达到预期的投资效果。

## (二) 重要提示

中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人。

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，任何一方均有权将争议提交华南国际经济贸易仲裁委员会，按照华南国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为深圳市。

基金产品资料概要信息发生重大变更的，基金管理人将在三个工作日内更新，其他信息发生变更的，基金管理人每年更新一次。因此，本文件内容相比基金的实际情况可能存在一定的滞后，如需及时、准确获取基金的相关信息，敬请同时关注基金管理人发布的相关临时公告等。

## 五、其他资料查询方式

以下资料详见平安基金官方网站

网址：[www.fund.pingan.com](http://www.fund.pingan.com) 客服电话：400-800-4800（免长途话费）

- 1、基金合同、托管协议、招募说明书
- 2、定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告
- 3、基金份额净值
- 4、基金销售机构及联系方式
- 5、其他重要资料